

Data Quality Monitor

– styr på data fra starten af dagen

Hvem er vi?



Peer Larsen

Product Owner



Henrik Bach

Business System Consultant

Agenda

01

Hvorfor bringer vi emnet op?

02

Inspiration fra
kundeinterviews
Forskellige typer af kvalitet

03

Hvad skal "Data Quality Monitor" indeholde?

Data Quality Monitor

Hvorfor bringer vi emnet op?

Data skal være "på plads",
"troværdige" og "klar" i PORTMAN

- Så tidligt som muligt
- Til brug for rapportering og investeringsbeslutninger

Brugergruppedage, business
support og reviews

- Tidskrævende og egenudviklede kontroller
- Databaseudtræk, traversering af logs, o.a.

Systemunderstøttelse i
PORTMAN

- Effektivisering, tidsmæssig besparelse
- Øget kvalitet af data

Data Quality Monitor

Kundeinterviews – vi har spurt nogle af vores kunder

GF Forsikring

The logo for GF Forsikring, featuring the letters 'GF' in white on a green rounded rectangle, with the word 'FORSIKRING' in white below it.

Eika Bolig Kreditt

The logo for Eika Bolig Kreditt, featuring the word 'eika.' in a green, lowercase, sans-serif font.

Oslo Pensjonsforsikring

The logo for Oslo Pensjonsforsikring, featuring a stylized blue 'P' inside a dark blue circle.

Kirkbi

The logo for Kirkbi, featuring a black icon of a grid of squares to the left of the word 'KIRKBI' in a bold, black, uppercase, sans-serif font.

Data Quality Monitor

Hvad forbinder vi med "Data Quality"?

Validitet

- Korrekt format, felter overholder regler

Fuldstændighed

- Leverancer og indhold er komplette

Aktualitet

- Opdaterede data der kommer rettidigt

Konsistens

- Identiske data på tværs af systemer, afstemning

Nøjagtighed

- Sande data, overensstemmelse med virkeligheden

Forretningsregler

- Mandater og rammer overholdes

Identifikation af ændringer

- Ændringer i data og beregninger
- Årsags- og virkningssammenhænge

Data Quality Monitor

Opsamling fra kundeinterviews – kommer data ind, og er de komplette?

Validering

- Fejl i import af data – format og syntaks
- Felter der ikke kan importeres (fx SWIFT-protokol)

Fuldstændighed – leverancer

- Er alle dagens data leveret og importeret?
- Er der kurser på alle instrumenter?

Fuldstændighed – felter

- NACE, CIC og rating på instrumenter
- Landekode på broker, modpart på handler
- UTI på derivater, varighed på obligationer

Aktualitet

- Er data modtaget rettidigt?
- Er pris og rating de nyeste?

Data Quality Monitor

Opsamling fra kundeinterviews – hænger data sammen, og er de sande?

Konsistens – eksternt

- Afstemning med bank og økonomisystem
- Likviditet, priser og beholdninger hos modparter
- EMIR og vedhængende renter

Konsistens – internt

- Instrument-NACE = issuer-NACE
- X-ray = 100 %
- Dagligt afkast = ændring i markedsværdi
- Primo = ultimo året før

Nøjagtighed – priser

- Afvigelser mod tærskler, tolerancer, std.afv.
- Rigtig pristype, fx NAV-lukkekurser
- Day count convention og vedhængende rente

Nøjagtighed – stamdata

- Store ændringer i credit rating
- Repo-/reverse- og variable rentesatser
- Pool faktorer, udbytter, kuponer, udsteder

Data Quality Monitor

Opsamling fra kundeinterviews – regler, ændringer og årsager

Forretningsregler

- Opdatering til bogførte transaktioner
- Shorthandler og udløbne lån
- Bliver rammerne (limits) overholdt?

Identifikation af ændringer

- Cashflow-parametre, terminsdatoer, rentesatser
- Pool faktorer
- Nye indlån
- Ændring af VaR
- 3 % tab rapporteres til bestyrelsen

Årsag / virkning

- Årsag til afvigelse mellem sidste og forrige pris
- Årsag til tab konstateret på porteføljen
- Hvorfor afviger ultimo fra primo året efter?

Data Quality Monitor

Standardløsning – generelt

Standardsoftware

- Skal dække fællesmængden af jeres behov

Minimal Viable Product (MVP)

- Noget der giver værdi
- Hurtigst muligt
- Til flest mulige kunder

Basis i ”behovspyramiden”

- De oplagte ting, de simple ting, ...

Data Quality Monitor

MVP – forretningsmæssigt indhold (eksempler)

Fuldstændighed

- Er alle priser modtaget?
- Er der NACE? Er der cirkulerende mængde?

Aktualitet

- Rettidigt?
- Er priserne aktuelle?
- Er der gamle ratings?

Nøjagtighed

- Er der store ændringer af priser, ratings? ...

Konsistens

- Er instrument og udsteder NACE identiske?

Identifikation af ændringer

- Change log på cashflow-parametre

Data Quality Monitor

Ikke MVP – forretningsmæssigt indhold (eksempler)

Årsags-/virkningssammenhænge

- Tab på portefølje overskrider tærskel
- Forskel i primo og ultimo værdier

Nøjagtighed

- Er rentesatser, udbytter, pool faktorer korrekte?
- Er udsteder korrekt?

Data Quality Monitor

IT-løsning (umiddelbart oplæg) – standard i PORTMAN, kundespecifikt udenom

PORTMAN Data Quality Monitor

Standardsoftware – fællesmængden, MVP

Automatisk overvågning (MVP)

- Er alle priser modtaget?
- Er der NACE og cirkulerende mængde?
- Er priserne aktuelle? Er der gamle ratings?
- Er der store ændringer af priser og ratings?
- Change log på cashflow-parametre

Adgang og indsigt

- Central GUI og API
- AI-assistent til ad hoc-undersøgelser

EKSTERN Data Quality Monitor

Kundespecifik udvidelse – uden for MVP

Kundespecifikke kontroller

- Indsamler status fra PORTMAN DQM
- Tilføjer kundespecifikke datakontroller
- Tærskel for tab på porteføljer
- Er rentesatser, pool faktorer, ... korrekte?

Notifikationer

- Afsender notifikationer pr. e-mail eller sms

Disclaimer

Dette materiale er udarbejdet af Vitec Aloc.

Materialet er udarbejdet alene til orientering for kunder eller andre, som materialet er udleveret til.

Materialet er informationsmateriale, og udgør ikke et tilbud fra Vitec. Moduler eller features nævnt i præsentationen er kun indeholdt i den endelige leverance såfremt disse er nævnt i den endelige kontrakt.

Alle råd og informationer i materialet er baseret på kilder som Vitec vurderer er pålidelige, men Vitec er hverken ansvarlig for fuldstændigheden eller nøjagtigheden af oplysningerne eller for direkte eller indirekte tab, som kan opstå på grund af fejl eller mangler heri.

Materialet bliver ikke opdateret, når først det er printet ud eller afleveret elektronisk.

Vitec har ophavsretten til materialet, som er udleveret til kundens personlige brug, og ikke til offentliggørelse noget sted.

Vitec Aloc A/S, (CVR nr. 14788484), Cortex Park Vest 3, 5230 Odense M